

Uchwała Nr 53/461/20
Rady Nadzorczej KDPW_CCP S.A.
z dnia 6 sierpnia 2020 r.

Na podstawie art. 48 ust. 15 ustawy z dnia 29 lipca 2005 r. o obrocie instrumentami finansowymi (tekst jednolity: Dz.U. z 2020 r. poz. 89) oraz § 15 ust. 2 pkt 13 Statutu KDPW_CCP S.A., Rada Nadzorcza KDPW_CCP S.A. postanawia, co następuje:

§ 1

W Regulaminie rozliczeń transakcji (obróć zorganizowany), stanowiącym załącznik do uchwały nr 9/9/10 Rady Nadzorczej KDPW_CCP S.A. z dnia 29 listopada 2010 r. (z późn. zm.), w § 48 ust. 3 otrzymuje brzmienie:

„3. Wielkość właściwego depozytu zabezpieczającego wymaganego od uczestnika jest wyznaczana przy wykorzystaniu parametrów ryzyka, ustalanych zgodnie ze Szczegółowymi Zasadami Prowadzenia Rozliczeń Transakcji (obróć zorganizowany), w odniesieniu do jego zobowiązań wynikających z transakcji, których rozliczenie zabezpiecza ten depozyt (ekspozycja uczestnika), w celu:

- 1/ pokrycia potencjalnej przyszłej ekspozycji uczestnika w następstwie stwierdzenia po jego stronie przypadku naruszenia,
- 2/ odzwierciedlenia aktualnej ekspozycji uczestnika wynikającej z faktycznych zmian cen rynkowych,
- 3/ pokrycia ryzyka wynikającego z płynności instrumentów finansowych oraz koncentracji pozycji w zakresie dotyczącym ekspozycji uczestnika, oraz
- 4/ pokrycia ryzyka wynikającego z korelacji między ekspozycją uczestnika a jego ryzykiem kredytowym.”.

§ 2

Uchwała wchodzi w życie dwa tygodnie po opublikowaniu przez Zarząd KDPW_CCP S.A. uchwały zatwierdzonej przez Komisję Nadzoru Finansowego.

Przewodniczący Rady Nadzorczej KDPW_CCP S.A.

dr Marek Dietl